e-file.lu

Rapports réglementaires

Manuel de saisie du TAF MiFID v1.2 via www.bourse.lu

Version 1.4

Ne pas communiquer ou reproduire sans autorisation de la Bourse de Luxembourg

Référence : ManuUtil_EFile_SaisieTAF-MiFID_FR.doc

1 Introduction : « GUI TAF » ou « Outil de saisie manuelle du TAF MiFID » ---------- 3

2 Comment y accéder ? ---------- 4

3 Le rapport de déclaration du TAF MiFID ---------- 7

3.1 Ouvrir le formulaire de déclaration du TAF MiFID ---------- 7

3.2 Remplir le formulaire ---------- 7

3.2.1 L'en-tête ---------- 7

3.2.2 La liste des déclarations ---------- 8

3.3 Importer un fichier xml existant ---------- 12

4 Les rapports d'annulation du TAF MiFID ---------- 13

4.1 Ouvrir l'un des formulaires d'annulation du TAF MiFID ---------- 13

4.2 Remplir le formulaire '**Annulation d'une transaction (TAF MiFID)**' ---------- 13

4.3 Remplir le formulaire '**Annulation de toutes les transactions (TAF MiFID)**' ---------- 14

5 Envoi d'un rapport TAF MiFID ---------- 15

6 Suivi d'un rapport et réponse de la CSSF ---------- 17

6.1 Comment accéder à e-file.lu ? ---------- 17

6.2 Suivi et Recherche des rapports TAF MiFID transmis ---------- 17

6.3 Réponses de la CSSF ---------- 19

1 Introduction : « GUI TAF » ou « Outil de saisie manuelle du TAF MiFID »

La Bourse de Luxembourg met à disposition des entités un outil de saisie manuelle du reporting TAF (Transactions Sur Actifs Financiers) à la norme MiFID via son portail internet www.bourse.lu.

La saisie des rapports s'effectue au travers de 3 formulaires PDF répondant aux instructions de la CSSF en vigueur (Recueil d'instructions TAF - Electronic Reporting Instructions (version 1.2 April 2008):

- Déclaration de transactions : Ce formulaire permet de remplir et d'envoyer à la CSSF une déclaration de reporting TAF MiFID au format v1.2. Il est possible d'y renseigner plusieurs transactions. De plus, un fichier XML conforme aux spécifications de la CSSF (circulaire CSSF 07/306 et 08/365) peut être importé pour renseigner directement le formulaire.
- Annulation d'une transaction : Ce formulaire permet de remplir et d'envoyer à la CSSF une demande d'annulation d'une ou de plusieurs transactions de reporting TAF MiFID précédemment déclarée.
- Annulation de toutes les transactions : Ce formulaire permet de remplir et d'envoyer à la CSSF une demande d'annulation d'un ou plusieurs reportings TAF MiFID précédemment déclarés. Toutes les transactions de chaque reporting seront annulées.

Enfin, la CSSF retourne au déclarant les feedbacks. La Bourse de Luxembourg met à disposition des entités ces feedbacks depuis le site www.e-file.lu.

2 Comment y accéder ?

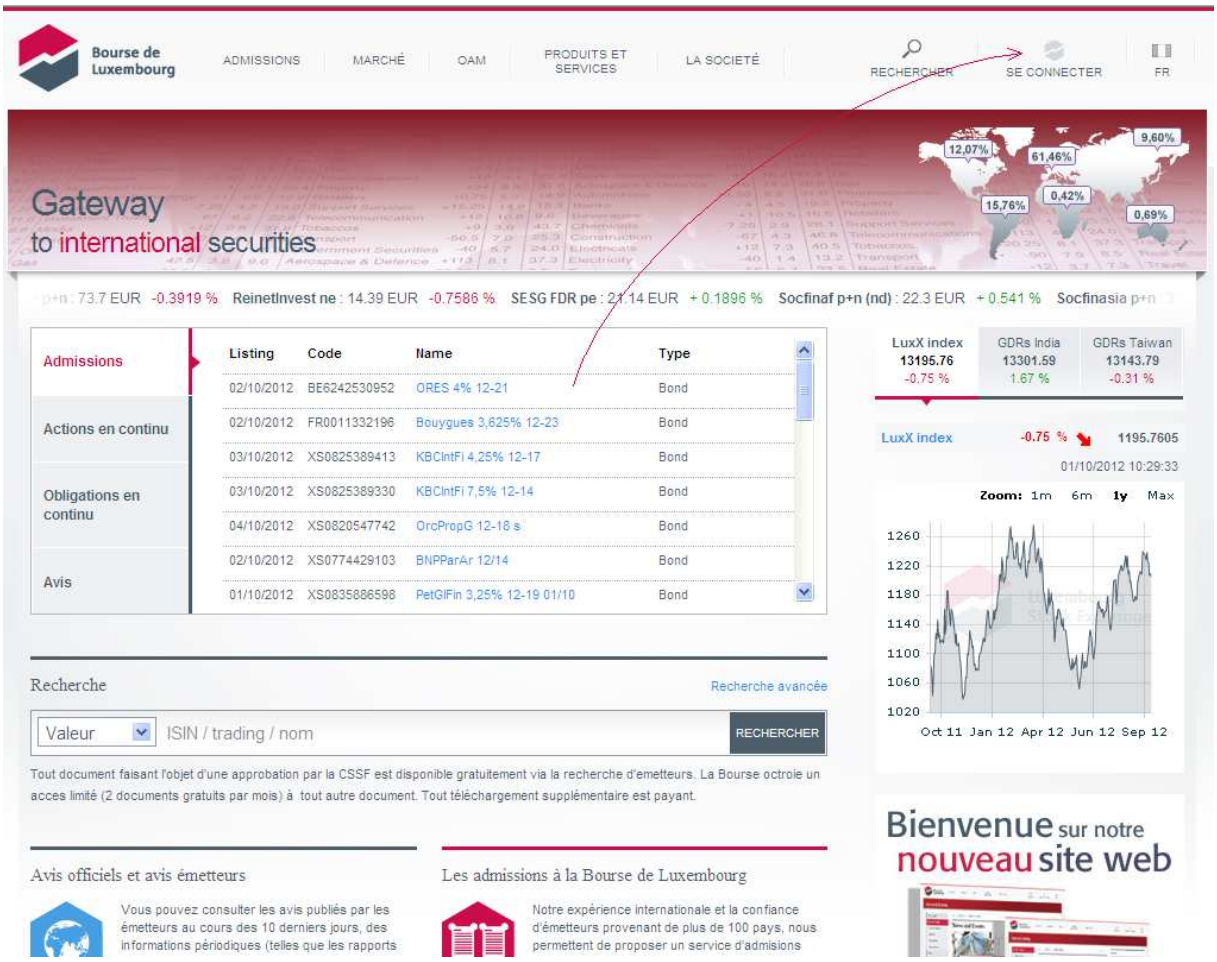
Les utilisateurs doivent au préalable disposer d'un login – mot de passe personnel pour se connecter à ce service sous www.bourse.lu .

Merci de contacter le Service Relations Clients pour plus d'informations :

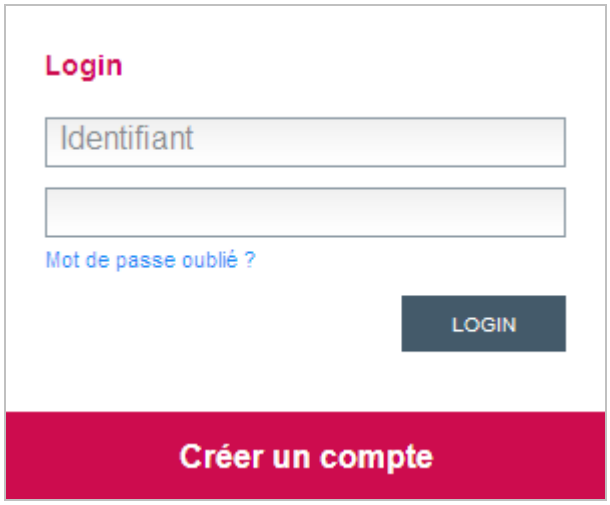
Service Relations Clients (CRM)

Tél: +352 47 79 36 - 529
Fax: +352 26 26 51 - 269
info@bourse.lu

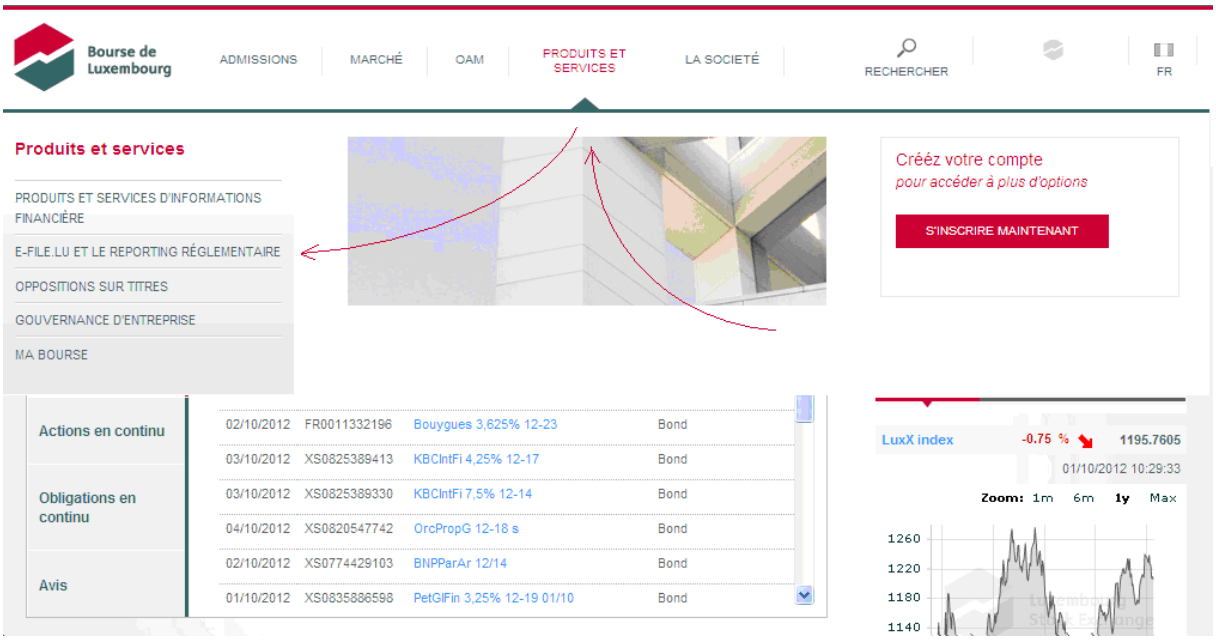
Si vous disposez déjà d'un login, allez sur www.bourse.lu et pointez 'SE CONNECTER' :


Bourse de Luxembourg
ADMISSIONS
MARCHÉ
OAM
PRODUITS ET SERVICES
LA SOCIETÉ
RECHERCHER
SE CONNECTER
FR
Gateway
to international securities
Admissions
Actions en continu
Obligations en continu
Avis
Listing Code Name Type
02/10/2012 BE6242530952 ORES 4% 12-21 Bond
02/10/2012 FR0011332196 Bouygues 3,625% 12-23 Bond
03/10/2012 XS0825389413 KBCIntFi 4,25% 12-17 Bond
03/10/2012 XS0825389330 KBCIntFi 7,5% 12-14 Bond
04/10/2012 XS0820547742 OrcPropG 12-18 s Bond
02/10/2012 XS0774429103 BNPParAr 12/14 Bond
01/10/2012 XS0835886598 PetGlFin 3,25% 12-19 01/10 Bond
LuxX index 13195.76 -0.75 %
GDRs India 13301.59 1.67 %
GDRs Taiwan 13143.79 -0.31 %
Recherche
Recherche avancée
Valeur
ISIN / trading / nom
RECHERCHER
Tout document faisant l'objet d'une approbation par la CSSF est disponible gratuitement via la recherche d'emetteurs. La Bourse octroie un acces limité (2 documents gratuits par mois) à tout autre document. Tout téléchargement supplémentaire est payant.
Avis officiels et avis émetteurs
Vous pouvez consulter les avis publiés par les émetteurs au cours des 10 derniers jours, des informations périodiques (telles que les rapports
Les admissions à la Bourse de Luxembourg
Notre expérience internationale et la confiance d'émetteurs provenant de plus de 100 pays, nous permettent de proposer un service d'admisions
Bienvenue sur notre nouveau site web

Saisissez alors votre login et votre mot de passe dans la petite fenêtre qui s'ouvre et cliquez sur 'SE CONNECTER' :

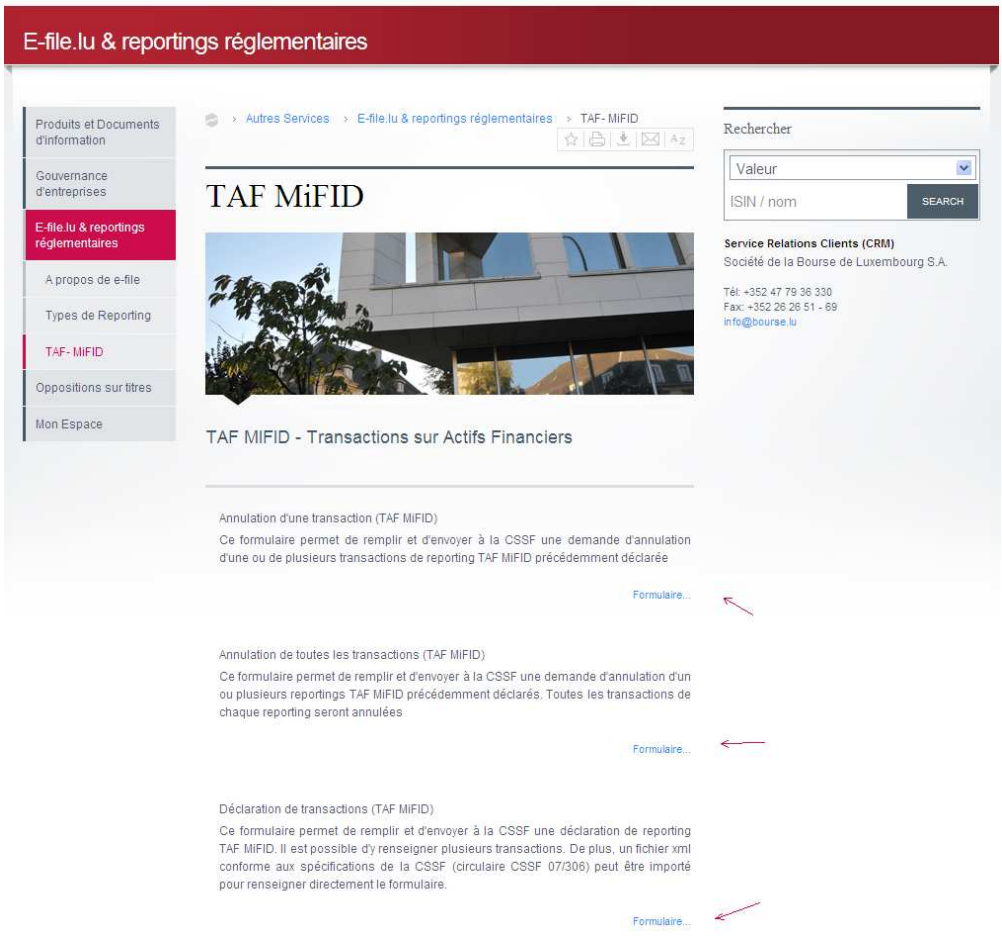


Une fois connectés, vous accédez au service en pointant 'PRODUITS ET SERVICES' puis cliquant 'E-FILE.LU & REPORTINGS RÉGLEMENTAIRES' dans le menu.



Vous obtenez la page suivante, choisissez 'TAF-MIFID', dans le menu de gauche :

La fenêtre de choix des formulaires apparaît alors :


E-file.lu & reportings réglementaires
Produits et Documents d'information
Gouvernance d'entreprises
E-file.lu & reportings réglementaires
A propos de e-file
Types de Reporting
TAF- MiFID
Oppositions sur titres
Mon Espace
Autres Services › E-file.lu & reportings réglementaires › TAF- MiFID
TAF MiFID
TAF MIFID - Transactions sur Actifs Financiers
Annulation d'une transaction (TAF MiFID)
Ce formulaire permet de remplir et d'envoyer à la CSSF une demande d'annulation d'une ou de plusieurs transactions de reporting TAF MiFID précédemment déclarée
Formulaire...
Annulation de toutes les transactions (TAF MiFID)
Ce formulaire permet de remplir et d'envoyer à la CSSF une demande d'annulation d'un ou plusieurs reportings TAF MiFID précédemment déclarés. Toutes les transactions de chaque reporting seront annulées
Formulaire...
Déclaration de transactions (TAF MiFID)
Ce formulaire permet de remplir et d'envoyer à la CSSF une déclaration de reporting TAF MiFID. Il est possible d'y renseigner plusieurs transactions. De plus, un fichier xml conforme aux spécifications de la CSSF (circulaire CSSF 07/306) peut être importé pour renseigner directement le formulaire.
Formulaire...
Rechercher
Valeur
ISIN / nom
SEARCH
Service Relations Clients (CRM)
Société de la Bourse de Luxembourg S.A.
Tél: +352 47 79 36 330
Fax: +352 26 26 51 - 69
info@bourse.lu

3 Le rapport de déclaration du TAF MiFID

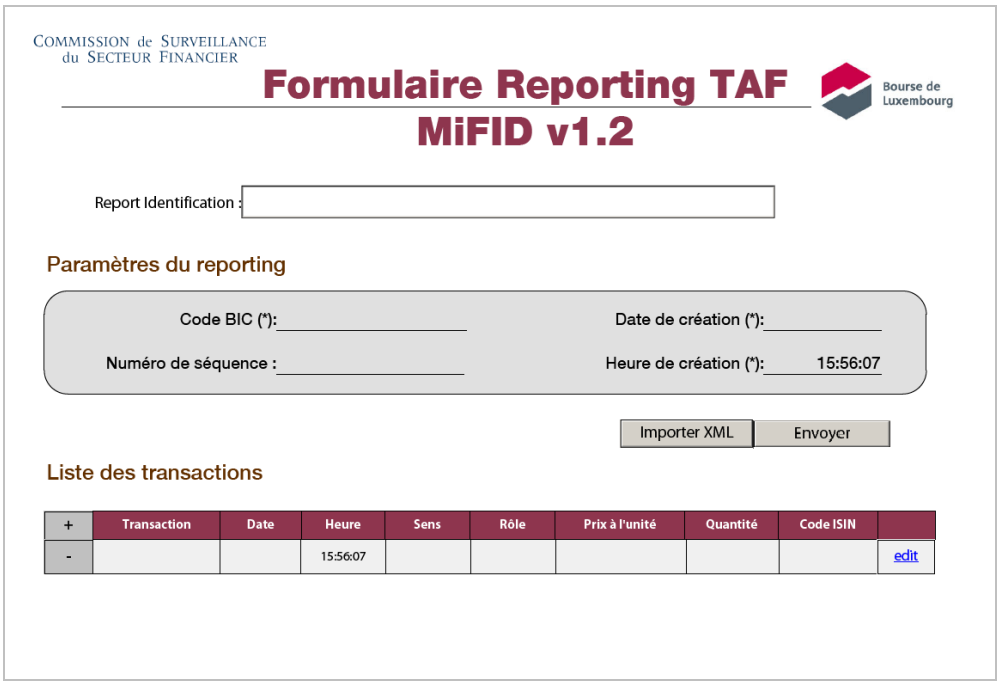
3.1 Ouvrir le formulaire de déclaration du TAF MiFID

Depuis la fenêtre de choix des formulaires, cliquez sur le lien 'Formulaire…' correspondant à la partie '**Déclaration de transactions (TAF MiFID)**'.

3.2 Remplir le formulaire

Le formulaire de déclaration est divisé en deux parties :

- l'entête : comprenant les paramètres principaux du rapport (notamment ceux servant à la génération du nom du fichier),
- la liste des transactions : listant le récapitulatif des déclarations saisies.



3.2.1 L'en-tête

Champ du PDF	XML CSSF	Descriptif	Format attendu	Obligatoire
Report Identification	ReportIdentification	Ce champ est **rempli automatiquement** par le formulaire lorsque les paramètres principaux sont renseignés.		oui
Code BIC (de Paramètres du reporting)	ReportIdentificationBIC	Code BIC de l'entité générant le rapport.	11 car.	oui

Numéro de séquence (de Paramètres du reporting)		C'est le numéro de séquence utilisé pour générer le Report Identification. Ce champ est initialisé à l'ouverture du formulaire de manière automatique.	6 digits	oui
Date de création (de Paramètres du reporting)	CreationDate	Initialisée à l'ouverture du formulaire et modifiable	YYYY-MM-DD	oui
Heure de création (de Paramètres du reporting)	CreationLocalTime	Initialisée à l'ouverture du formulaire et modifiable	HH:MM:SS	oui

Commentaire concernant le Numéro de Séquence :

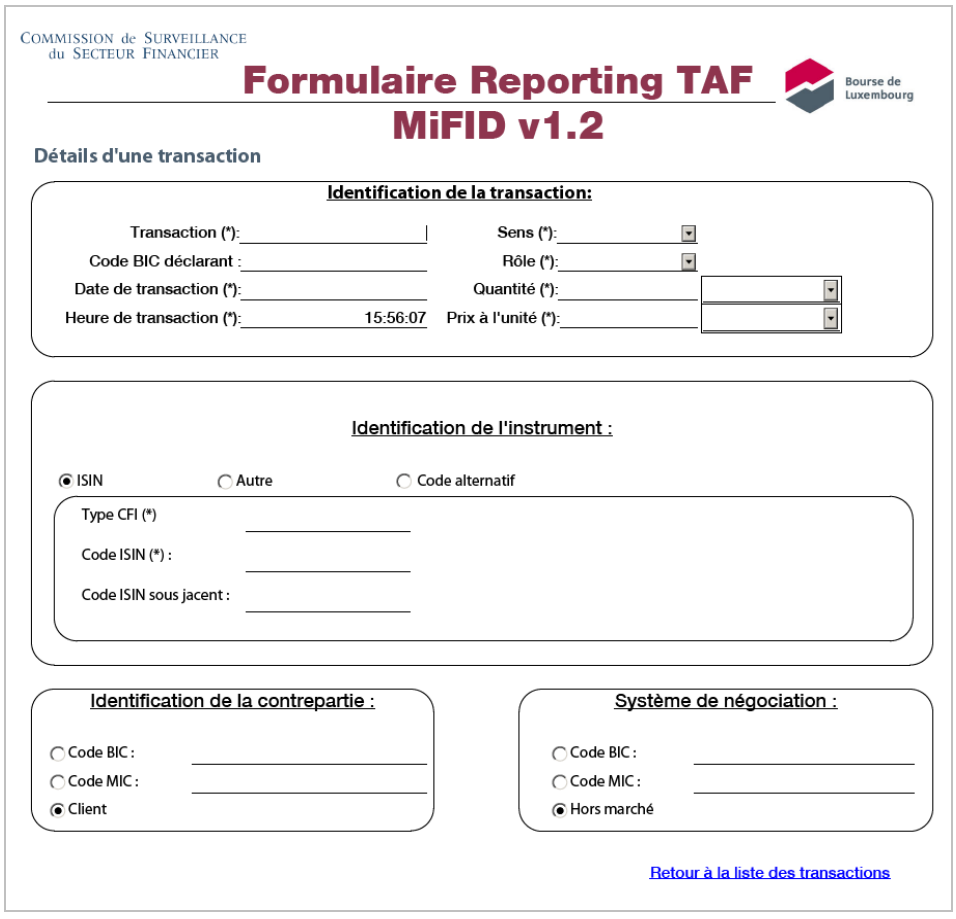
Il est cependant possible de modifier ce champ avec une valeur supérieure à celle initialisée.

Le numéro de séquence est commun aux 3 formulaires de saisie du TAF MiFID. Il s'incrémente de 1 en 1 jusqu'à 999999.

3.2.2 La liste des déclarations

Pour saisir les transactions, utiliser les liens 'edit' pour aller directement au détail d'une transaction et « + » / « - » pour ajouter et supprimer des transactions.

Voici le détail d'une transaction à saisir :



Identification de la transaction :

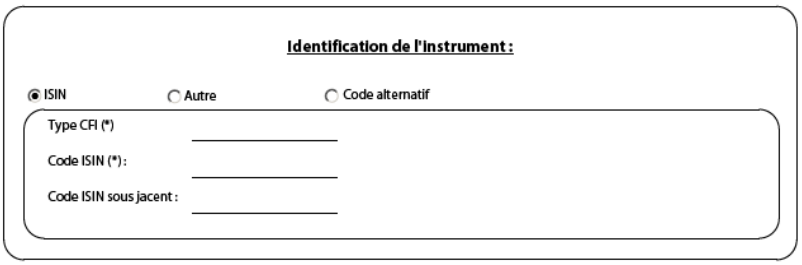
Champs du PDF	XML CSSF	Descriptif	Format attendu	Obligatoire
Transaction	TransactionIdentification	Identifiant unique de la transaction	15 car.	oui
Code BIC déclarant	DeclarationIdentificationBIC	Code BIC de la branche qui a effectué la transaction.	11 car.	non
Date de transaction	TradingDay		YYYY-MM-DD	oui
Heure de transaction	TradingLocalTime		HH:MM:SS	oui
Sens	BuySellIndicator	Achat ou Vente	Choix dans liste	oui
Rôle	TradingCapacity	Agent ou Principal	Choix dans liste	oui
Quantité	Quantity		19 digits (dont 5 décimales)	oui
Type d'unité	Notation (Quantity)	Nombre d'unités ou de contrats ou Valeur nominale	Choix dans liste	oui
Prix à l'unité	Unit Price	Prix par instrument hors commission	19 digits (dont 5 décimales)	
Devise	Notation (Unit Price)	Selon liste de choix.	Choix dans liste	oui

Identification de l'instrument :

Dans cette partie, il faut choisir entre trois modes d'identification :

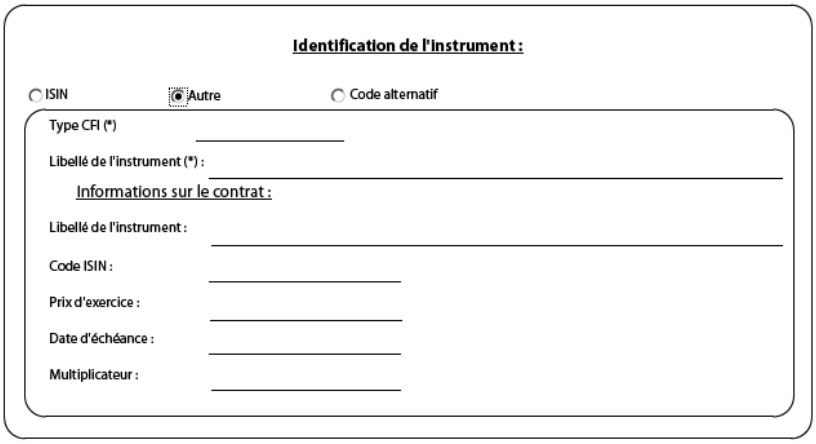
- soit ISIN
- soit Code alternatif
- soit Autre.

Si vous saisissez votre instrument par le ***mode « ISIN »***, vous devez saisir :



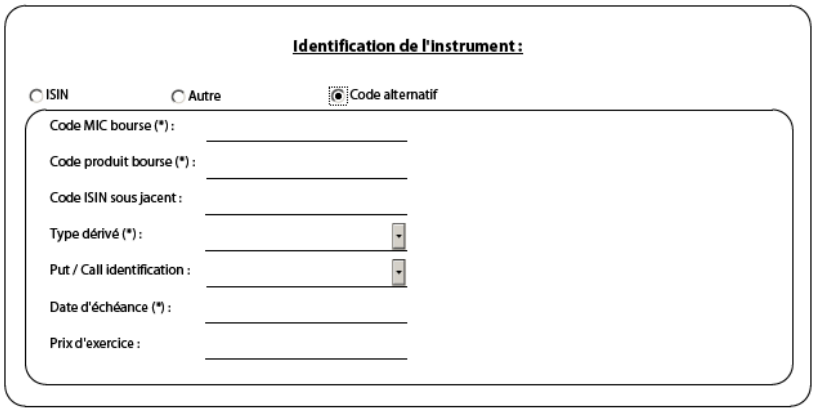
Champs du PDF	XML CSSF	Descriptif	Format attendu	Obligatoire
Type CFI	InstrumentTypeCFI	Classification des Instruments Financiers	6 car. Maxi en MAJUSCULES	oui
Code ISIN	InstrumentIdentificationISIN	Code ISIN de l'instrument financier	11 car.	oui
Code ISIN sous-jacent	UnderlyingInstrumentIdentificationISIN	Code ISIN sous-jacent	11 car.	non

Si vous saisissez votre instrument par le ***mode « Autre »***, vous devez saisir :



Champs du PDF	XML CSSF	Descriptif	Format attendu	Obligatoire
Type CFI	InstrumentTypeCFI	Classification des Instruments Financiers	6 car. Maxi en MAJUSCULES	oui
Libellé de l'instrument	InstrumentIdentificationLabel	Description textuelle de l'instrument	Maxi 120 car.	oui
Libellé de l'instrument (Informations sur le contrat dérivé)	UnderlyingInstrumentIdentificationLabel	Description textuelle de l'instrument sous-jacent	Maxi 120 car.	non
Code ISIN (Informations sur le contrat dérivé)	UnderlyingInstrumentIdentificationISIN	Code ISIN de l'instrument sous-jacent	11 car.	non
Prix d'exercice (Informations sur le contrat dérivé)	StrikePrice	Prix d'exercice du contrat dérivé	19 digits (dont 5 décimales)	non
Date d'échéance (Informations sur le contrat dérivé)	ExpiryDate	Date d'exercice ou date d'échéance du contrat dérivé	YYYY-MM-DD	non
Multiplicateur (Informations sur le contrat dérivé)	PriceMultiplier		19 digits (dont 5 décimales)	non

Si vous saisissez votre instrument par le ***mode « Code alternatif »***, vous devez saisir :



Champs du PDF	XML CSSF	Descriptif	Format attendu	Obligatoire
Code MIC bourse	ExchangeCode	Code identifiant le marché réglementé sur lequel l'instrument dérivé est admis à la négociation, c'est-à-dire le « lieu d'admission »	4 car. composés de lettres MAJUSCULES et chiffres	oui
Code produit bourse	ProductCode	Code du produit sur le marché	12 car. maximum composés de lettres MAJUSCULES et chiffres	oui
Code ISIN sous-jacent	UnderlyingInstrumentIdentificationISIN	Code ISIN	11 car.	non
Type dérivé	DerivatedType	Type de contrat dérivé : Option ou Future	Choix dans liste	oui
Put / Call identification	PutCallIdentifier	Type d'option : option de vente ou d'achat ou futur	Choix dans liste	non
Date d'échéance	ExpiryDate	Date d'exercice ou date d'échéance du contrat dérivé	YYYY-MM-DD	oui
Prix d'exercice	StrikePrice	Prix d'exercice	19 digits (dont 5 décimales)	non

Identification de la contrepartie :

Il faut **obligatoirement** choisir l'une de ces 3 possibilités :

Champs du PDF	XML CSSF	Descriptif	Format attendu	Obligatoire
Code BIC	CounterPartyIdentificationBIC	Code BIC identifiant la contrepartie. A renseigner si la contrepartie est une société d'investissement.	11 car.	non
Code MIC	CounterPartyIdentificationMIC	Code MIC identifiant la contrepartie. A renseigner si la contrepartie est un marché régulier ou un MTF (Multilateral Trading Facility).	4 car.	non
Client	CounterPartyCustomer	Valeur par défaut. A renseigner si la contrepartie n'est ni une société d'investissement, ni un marché, ni un MTF ni une entité agissant comme contrepartie centrale.	-	non

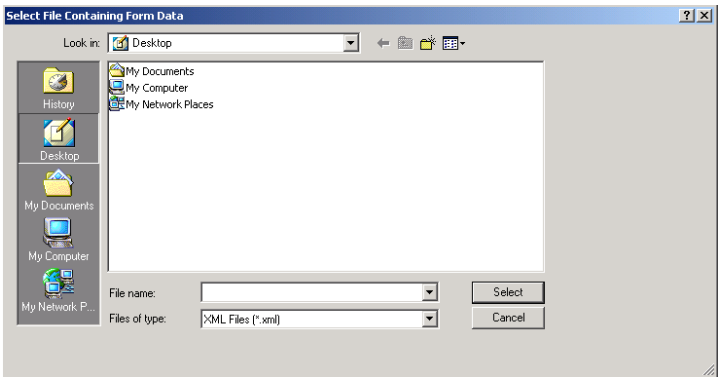
Système de négociation :

Il faut **obligatoirement** choisir l'une de ces 3 possibilités :

Champs du PDF	XML CSSF	Descriptif	Format attendu	Obligatoire
Code BIC	TradingVenueIdentification BIC	Code BIC du système de négociation où la transaction a eu lieu	11 car.	non
Code MIC	TradingVenueIdentification MIC	Code MIC du système de négociation où la transaction a eu lieu	4 car.	non
Hors marché	TradingVenueXOFF	Valeur par défaut. La transaction a été effectuée hors marché.	-	non

3.3 Importer un fichier xml existant

Un bouton 'Importer' situé sous l'entête permet d'importer des données issues d'un fichier XML de TAF MiFID existant par simple upload :



4 Les rapports d'annulation du TAF MiFID

4.1 Ouvrir l'un des formulaires d'annulation du TAF MiFID

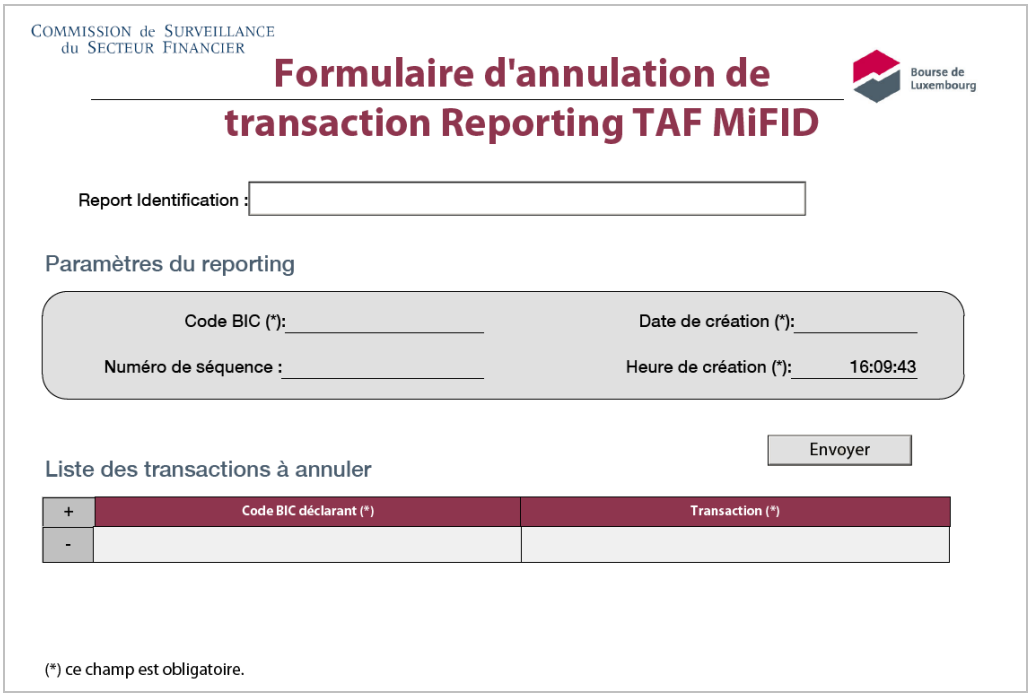
Depuis la fenêtre de choix des formulaires, cliquer sur le lien 'Formulaire…' correspondant à l'une de ces deux parties selon votre besoin :

- '**Annulation d'une transaction (TAF MiFID)**' : Ce formulaire permet de remplir et d'envoyer à la CSSF une demande d'annulation d'une ou de plusieurs transactions de rapport TAF MiFID précédemment déclarée.
- '**Annulation de toutes les transactions (TAF MiFID)**' : Ce formulaire permet de remplir et d'envoyer à la CSSF une demande d'annulation d'un ou plusieurs rapports TAF MiFID précédemment déclarés. Toutes les transactions de chaque rapport seront annulées.

4.2 Remplir le formulaire '**Annulation d'une transaction (TAF MiFID)**'

Ce formulaire permet l'annulation d'une liste définie de transactions. Le formulaire est ainsi divisé en deux parties :

- l'entête : comprenant les paramètres principaux du rapport (notamment ceux servant à la génération du nom du fichier). Cette partie est identique au formulaire de déclaration,
- la liste des transactions : listant le récapitulatif des déclarations à annuler.



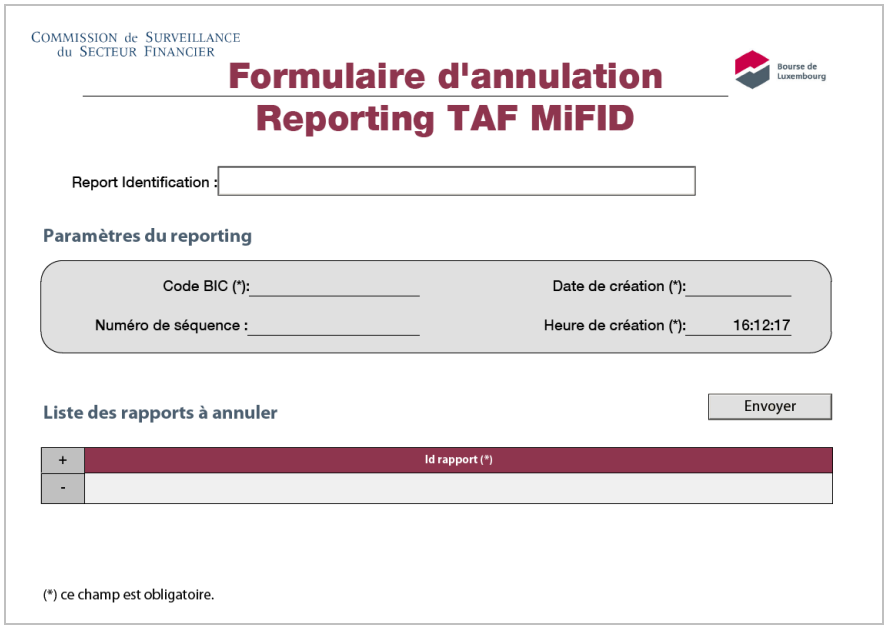
Dans la liste des transactions, il suffit d'utiliser les boutons « + » / « - » pour ajouter et supprimer des transactions. Pour chaque ligne, il faut obligatoirement renseigner les champs :

- 'Code BIC déclarant' sur 11 caractères,
- 'Transaction' sur 15 caractères.

4.3 Remplir le formulaire '**Annulation de toutes les transactions (TAF MiFID)**'

Ce formulaire d'annulation permet l'annulation d'une liste définie de rapports. Le formulaire est ainsi divisé en deux parties :

- l'entête : comprenant les paramètres principaux du rapport (notamment ceux servant à la génération du nom du fichier). Cette partie est identique au formulaire de déclaration,
- la liste des rapports à annuler : listant le récapitulatif des rapports à annuler.


COMMISSION de SURVEILLANCE du SECTEUR FINANCIER

Formulaire d'annulation
Reporting TAF MiFID

Bourse de Luxembourg

Report Identification :

Paramètres du reporting

Code BIC (*): Date de création (*):

Numéro de séquence : Heure de création (*): 16:12:17

Liste des rapports à annuler

Envoyer

+	Id rapport (*)
-	

(*) ce champ est obligatoire.

Dans la liste des rapports, il suffit d'utiliser les boutons « + » / « - » pour ajouter et supprimer des rapports à annuler. Pour chaque ligne, il faut obligatoirement renseigner le champs 'Id rapport' selon le formalisme suivant :

ReporterIdentificationBIC_Date_SequenceNumber

Avec

ReporterIdentificationBIC : code BIC du déclarant sur 11 caractères,

Date : la date de génération du rapport à annuler au format YYYY-MM-DD,

SequenceNumber : le numéro de séquence du rapport à annuler sur 6 digits.

Exemple :

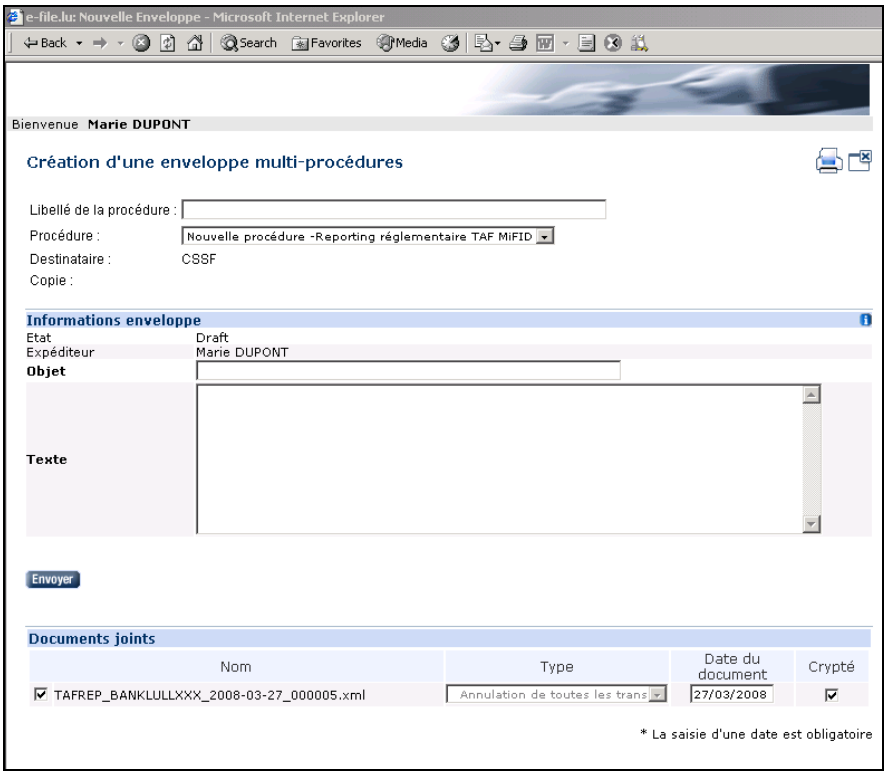
BANKLULLXXX_2007-07-10_000142 .

5 Envoi d'un rapport TAF MiFID

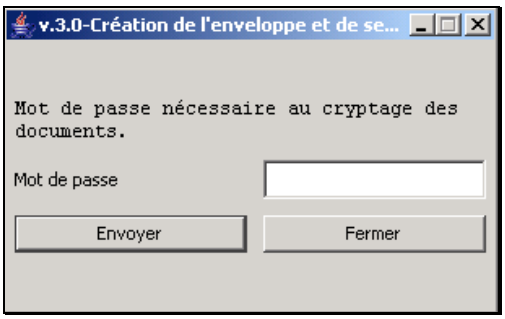
Vous trouverez dans chacun des 3 formulaires TAF MiFID un bouton 'Envoyer'.

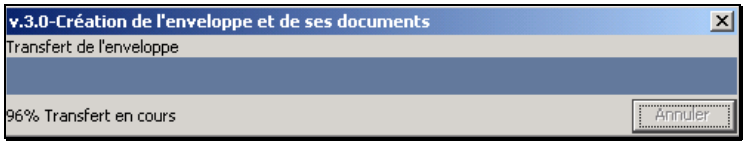
Lorsque vous avez fini la saisie de votre rapport, cliquez sur ce bouton 'Envoyer' pour effectuer l'envoi vers la CSSF. La page suivante apparaît. Il faut alors renseigner les paramètres d'envois. Pour rappel, cet envoi va être effectué au travers de la plateforme e-file : il faut donc renseigner un objet et un texte (données obligatoires) et presser à nouveau 'Envoyer'.

Remarque concernant cette page : le nom du fichier joint à l'envoi est visible en bas de page (ici, TAFREP_BANKLULLXXX_2008-03-27_00005.xml).

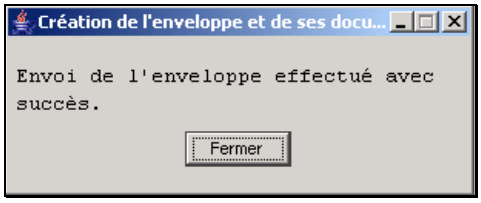


Il faut ensuite crypter le fichier en saisissant le mot de passe nécessaire au cryptage du document dans la boîte de dialogue suivante et presser 'Envoyer':





Une fois l'envoi terminé, cette boîte apparaît :



6 Suivi d'un rapport et réponse de la CSSF

Le suivi des envois et les réponses de la CSSF s'effectue depuis la plateforme www.e-file.lu.

Cette partie du document donne ainsi un aperçu rapide des moyens à votre disposition pour suivre vos envois et accéder aux feedbacks renvoyés par la CSSF dans le cadre du reporting TAF MiFID. Cependant, pour aller plus loin dans l'utilisation d'e-file, nous vous conseillons de vous reporter directement au manuel d'utilisation e-file disponible en ligne. Enfin, cette partie nécessite la connaissance des notions de base e-file : dossier, procédure, enveloppe et document, également explicitées dans le manuel e-file.

6.1 Comment accéder à e-file.lu ?

Les utilisateurs doivent au préalable disposer d'un login – mot de passe personnel pour se connecter à ce service sous www.e-file.lu.

Merci de contacter le Service Relations Clients pour plus d'informations :

Service Relations Clients (CRM)

Tél: +352 47 79 36 - 529
Fax: +352 26 26 51 - 269
info@bourse.lu

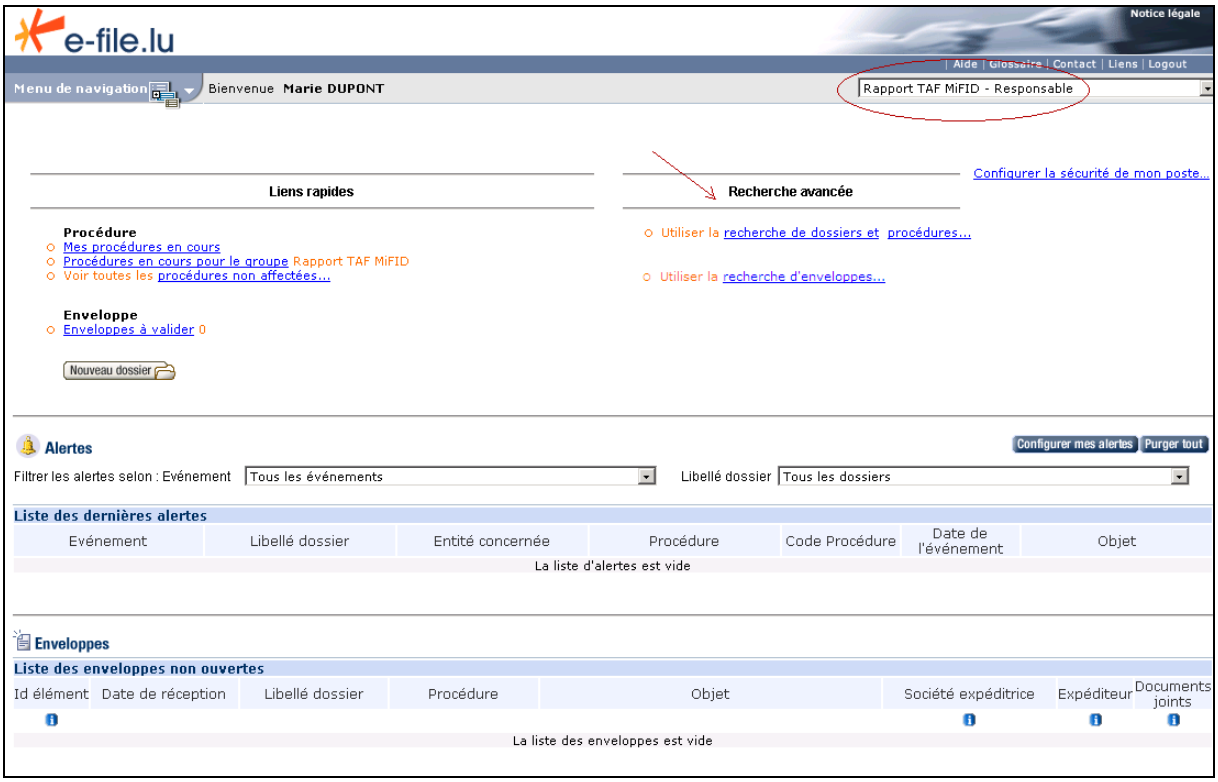
Si vous disposez déjà d'un login, aller directement sur www.e-file.lu. Renseigner vos login et mot de passe et presser 'Valider'. (attention : ils peuvent être différents pour les portails www.bourse.lu et www.e-file.lu).

6.2 Suivi et Recherche des rapports TAF MiFID transmis

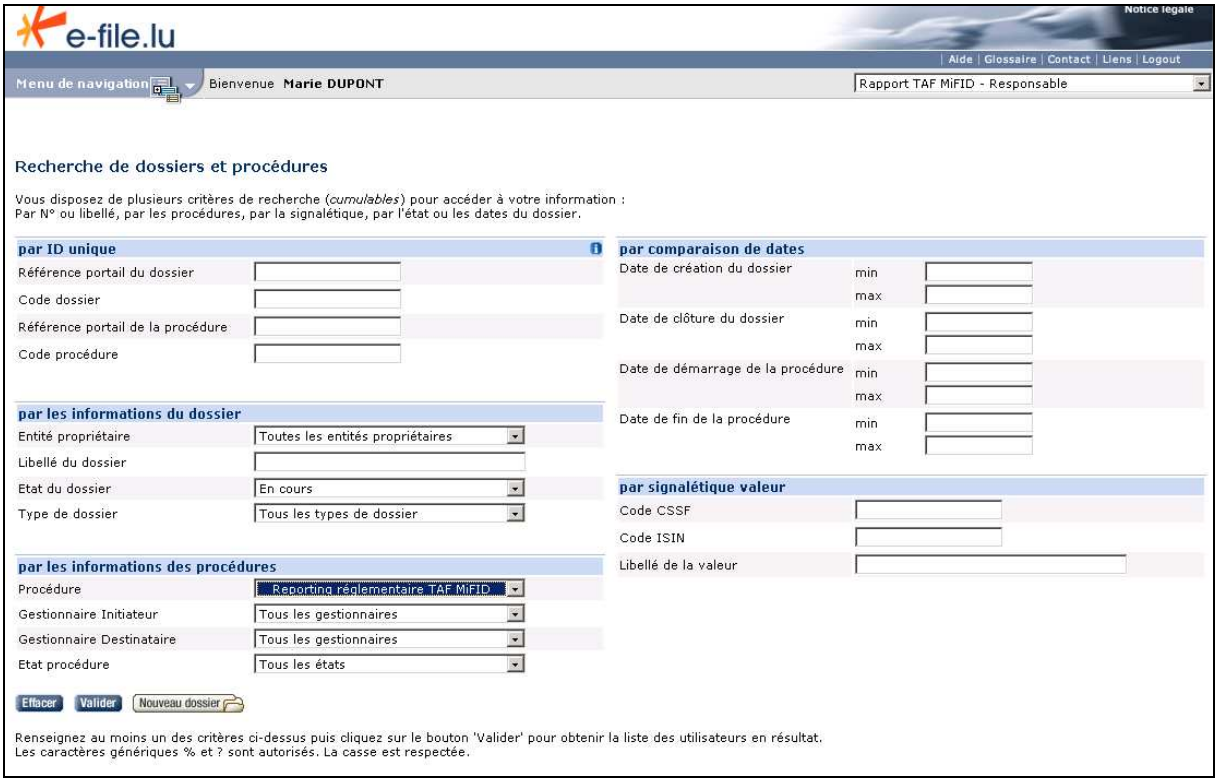
Une fois connecté à www.e-file.lu, la page d'accueil apparaît.

Pour rechercher vos envois de rapport TAF MiFID, il faut dans un premier temps sélectionner le contexte « Rapport TAF MiFID - … » dans la liste de choix située en haut à droite de la page d'accueil.

Utiliser ensuite un des liens de recherche sous 'Recherche avancée'.



Une page de recherche avancée s'affiche :


e-file.lu
Notice légale
Aide | Glossaire | Contact | Liens | Logout
Menu de navigation
Bienvenue Marie DUPONT
Rapport TAF MiFID - Responsable
Recherche de dossiers et procédures
Vous disposez de plusieurs critères de recherche (cumulables) pour accéder à votre information :
Par N° ou libellé, par les procédures, par la signalétique, par l'état ou les dates du dossier.
par ID unique
Référence portail du dossier
Code dossier
Référence portail de la procédure
Code procédure
par les informations du dossier
Entité propriétaire
Toutes les entités propriétaires
Libellé du dossier
Etat du dossier
En cours
Type de dossier
Tous les types de dossier
par les informations des procédures
Procédure
Reporting réglementaire TAF MiFID
Gestionnaire Initiateur
Tous les gestionnaires
Gestionnaire Destinataire
Tous les gestionnaires
Etat procédure
Tous les états
par comparaison de dates
Date de création du dossier
Date de clôture du dossier
Date de démarrage de la procédure
Date de fin de la procédure
min
max
par signalétique valeur
Code CSSF
Code ISIN
Libellé de la valeur
Effacer
Valider
Nouveau dossier
Renseignez au moins un des critères ci-dessus puis cliquez sur le bouton 'Valider' pour obtenir la liste des utilisateurs en résultat.
Les caractères génériques % et ? sont autorisés. La casse est respectée.

Saisir vos critères et faire 'Valider' pour lancer la recherche.

La liste des résultats s'affiche en listant les dossiers et procédures relatifs aux critères saisis.

En cliquant sur les liens présents dans la liste des procédures, la fiche procédure s'affiche.

Etat des procédures :

L'état de la procédure donne l'indication d'avancement de la transmission.

Si Etat = ***Créée***, la procédure est créée mais l'enveloppe n'est pas encore transmise.

Si Etat = ***Démarrée***, la transmission est bien initialisée dans e-file.

Si Etat = ***Clôturée***, la transmission est arrivée à l'autorité qui est en train de traiter votre fichier reporting et répondra par un feedback dans la même procédure (voir l'onglet 'Enveloppes & Documents').

Enveloppes & Documents :

Depuis la fiche procédure vous pouvez visualiser le document transmis en sélectionnant l'onglet 'Enveloppes & Documents'.

Deux listes sont alors disponibles : les envois effectués et les enveloppes reçues.

6.3 Réponses de la CSSF

Les retours (fichiers de feedback) de la CSSF sont renvoyés sous www.e-file.lu.

Les enveloppes reçues sont visibles directement dans l'accueil jusqu'à ce qu'elles soient lues. Une fois qu'elles sont lues, il est toujours possible de les retrouver par la recherche avancée (cf. paragraphe précédent).